

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年9月6日-9月10日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周五（9月10日）报6.4566，较前周升值约0.02%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.24%，上周最高6.4363、最低6.4678，收于6.4408，波幅0.49%。上周境内人民币汇率双边震荡，主要受中美领导人通话、中国外贸数据较好、中美利差小幅扩大等因素共同影响。预计本周人民币汇率震荡偏强，主要受美联储维持宽松货币政策、欧美疫情防控仍不确定等因素影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.4200-6.4800。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较清淡，掉期点呈震荡上行走势。截至上周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上行78个点，上周最高1754、最低1668，收于1745，波幅4.93%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周下行89个点，上周最高6.6454、最低6.5911，收6.6262，波幅0.82%。

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。

表 1：境内美元对人民币汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较前周 (点)	较上月 末(点)	较去年 末(点)
即期汇率						
中间价	—	—	6.4566	-11	-113	-683
银行间市场汇价	6.4363	6.4678	6.4408	-157	-237	-990
掉期点						
1 个月期限	215	187	204	9.5	-2	74
2 个月期限	371.5	329.5	360	23	37	88
3 个月期限	501	458.5	498	32.5	58	113
6 个月期限	952	891.7	950	55	91	210
1 年期限	1754	1668	1745	78	126	314

数据来源：路透

表 2：境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较前周 (点)	较去年末 (点)	与境内价 差(点)
1 个月期限	6.4953	6.4343	6.4622	50	-640	10
2 个月期限	6.5073	6.4484	6.4782	77	-600	14
3 个月期限	6.5239	6.4656	6.4937	86	-575	31
6 个月期限	6.5638	6.5078	6.5412	86	-458	54
1 年期限	6.6454	6.5911	6.6262	89	-330	109

数据来源：路透

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。